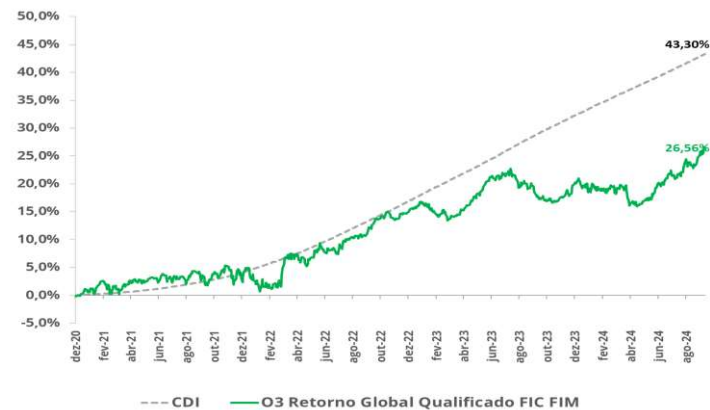


O fundo tem como objetivo obter ganhos de capital mediante operações nos mercados de juros, câmbio, ações, commodities, dívida, além de exposição ainda que indireta em ativos digitais, utilizando-se de instrumentos tanto nos mercados à vista quanto nos de derivativos. Poderá utilizar-se, entre outros, de mecanismos de hedge, operações de arbitragem e alavancagem. A exposição dependerá, entre outros fatores, da liquidez e volatilidade dos mercados em que estiver atuando.

Rentabilidade mensal

	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Ano	* em 18/12/2020 Desde o início*
O3 RET G QF	-1,10%	-0,37%	0,87%	-2,54%	0,61%	2,05%	1,47%	1,39%	2,57%				4,95%	26,56%
2024	% CDI	-	104%	-	74%	259%	162%	160%	308%				62%	61%
	CDI +	-2,07%	-1,17%	0,04%	-3,42%	-0,22%	1,26%	0,56%	1,74%				-3,04%	-16,74%
O3 RET G QF	0,39%	-1,33%	-0,26%	1,60%	2,46%	1,99%	1,13%	-2,15%	-2,08%	-0,84%	1,80%	1,61%	4,24%	20,59%
2023	% CDI	34%	-	-	174%	219%	185%	105%	-	-	196%	180%	33%	63%
	CDI +	-0,74%	-2,25%	-1,44%	0,68%	1,34%	0,92%	0,05%	-3,29%	-3,05%	-1,84%	0,88%	0,72%	-8,80%
O3 RET G QF	-2,74%	0,07%	4,49%	0,30%	0,87%	0,26%	1,48%	0,46%	2,18%	1,94%	-0,11%	0,89%	10,40%	15,69%
2022	% CDI	-	10%	486%	36%	84%	26%	143%	40%	204%	190%	-	79%	90%
	CDI +	-3,47%	-0,68%	3,57%	-0,54%	-0,16%	-0,75%	0,44%	-0,70%	1,11%	0,92%	-1,13%	-0,23%	-1,70%
O3 RET G QF	0,02%	0,75%	0,16%	1,18%	0,58%	0,58%	-0,63%	0,89%	-1,96%	1,53%	-0,65%	2,00%	4,47%	4,78%
2021	% CDI	13%	558%	80%	569%	217%	189%	-	210%	-	318%	-	262%	107%
	CDI +	-0,13%	0,62%	-0,04%	0,97%	0,31%	0,27%	-0,98%	0,42%	-2,40%	1,05%	-1,24%	1,24%	0,33%

Rentabilidade Fundo X CDI



Atribuição de Performance

	Mês	Ano	12M
Ações	1,76%	4,61%	4,85%
Commodities	0,01%	0,41%	0,19%
Moedas	0,04%	-1,26%	-1,11%
Renda Fixa	0,65%	-1,23%	-0,46%
Quantitativo	0,00%	0,00%	0,04%
Caixa	0,31%	3,87%	6,22%
Custos	-0,20%	-1,46%	-2,08%
O3 Ret GI Quali	2,57%	4,95%	7,65%

Patrimônio em 30/09/2024

PL Atual	R\$ 142.754.474,45
PL Médio (12 meses)	R\$ 182.852.017,69

Estatísticas

Descrição	2024	* em 18/12/2020 Início*
Volatilidade anualizada	5,40%	5,29%
Melhor mês	2,57%	4,49%
Pior mês	-2,54%	-2,74%

Informações complementares

Gestor: O3 Gestão de Recursos LTDA
Administrador: BTG Pactual Serviços Financeiros S/A DTVM
Custodiante: Banco BTG Pactual S.A
Auditor: Ernst & Young
Risco: Lote 45
Categoria ANBIMA: Multimercado Macro
Tributação: Longo prazo

Público: Investidor Qualificado
Investimento inicial mínimo: R\$ 5.000
Movimentação mínima: R\$ 1.000
Aplicação: até às 14h30. **Cotização:** D+1
Resgate: até às 14h30. **Cotização:** D+30.
Pagamento: D+1
Taxa de Adm.: 1,95%a.a.
Taxa de Perf.: 20% sobre o que exceder CDI

Comentário do gestor

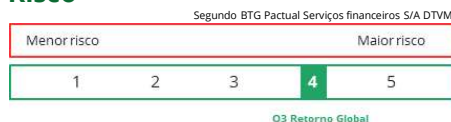
Destaques do mês:

Em setembro, ganhos ficaram concentrados em posições compradas na bolsa norte-americana e ações de tecnologia na China. Em renda fixa, estratégias visando a queda de juro nos EUA e México contribuíram positivamente, assim como as posições compradas em inclinação nos EUA e na China. Em crédito, posição comprada no índice High Yield norte-americano contribuiu positivamente. Em moedas, destaque negativo veio de posições vendidas no Yuan chinês e positivo veio da estratégia comprada no Peso mexicano. Nas commodities, posições compradas em cobre contribuíram positivamente.

Posicionamento atual:

Em renda fixa, seguimos comprados em inclinação de curva nos EUA e na China, além de posições esperando queda de juros nos EUA e no México. Em renda variável, seguimos com uma postura tática em relação às bolsas. Em relação às moedas, saímos de posições vendidas no Yuan chinês e continuamos com a estratégia comprada no peso mexicano. Adicionamos posições vendidas no Peso chileno e compradas no Yen japonês. Nas commodities, seguimos com posições compradas em cobre.

Risco



Acompanhe nossas redes sociais:

Avenida Brigadeiro Faria Lima, 2.277, 22º andar, Jd. Paulistano – CEP: 01452-000, São Paulo - SP | E-mail: contato@o3capital.com.br | www.o3capital.com.br | [Youtube: O3 Capital](https://www.youtube.com/O3Capital)